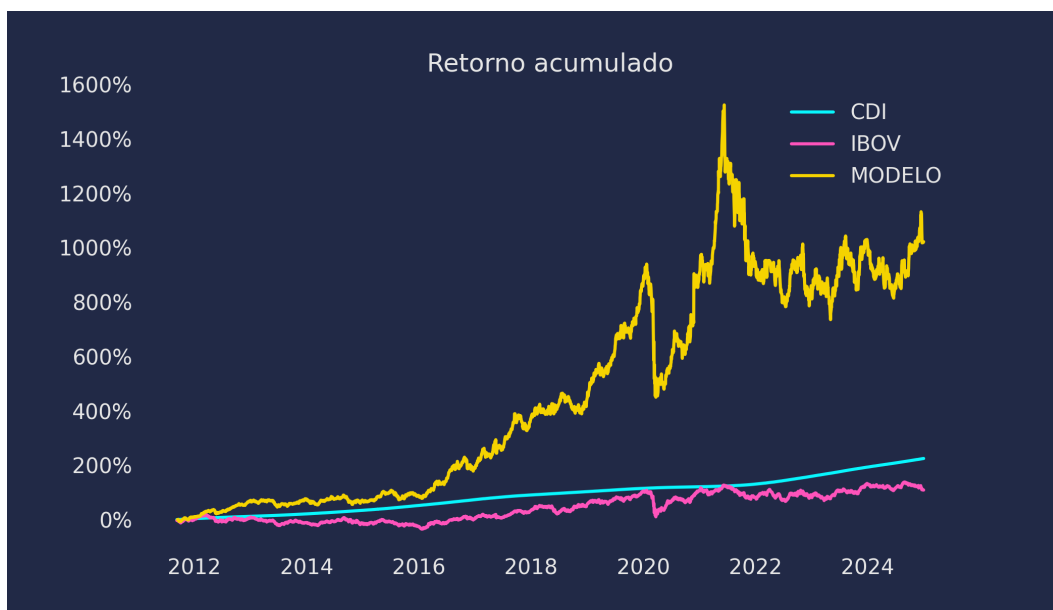


Relatório do Modelo

Dia inicial	2011-09-09
Dia final	2024-12-30
Dias totais	3304

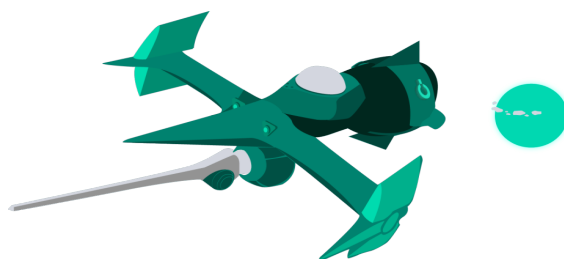


Estatísticas de Retorno e Risco

Retorno acum. modelo	1021.25%
Retorno acum. CDI	224.65%
Retorno acum. IBOV	108.74%
Retorno a.a. modelo	20.24%
Vol 252d	19.85%
Índice Sharpe	0.46
VAR diário 95%	-2.12%
Turn over carteira	29.26%
Drawdown máximo	-48.59%

Estatísticas de Trade

Número de carteiras	157
% Operações vencedoras	58.6%
% Operações perdedoras	41.4%
Média de ganhos	6.42%
Média de perdas	-4.68%
Expec. matemática por trade	1.83%
Maior sequência de vitória	6
Maior sequência de derrotas	6
% Meses carteira > IBOV	58.23%



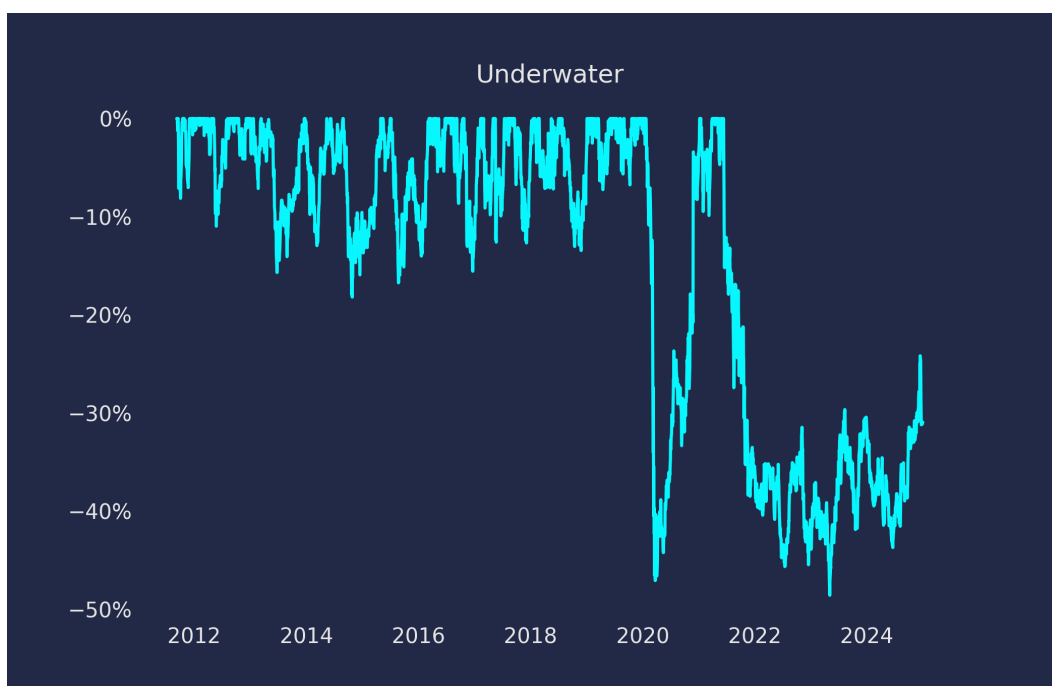
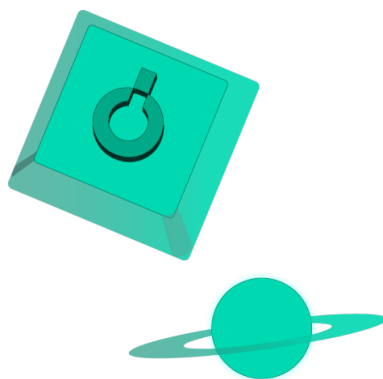
Relatório do Modelo

Eventos de estresse

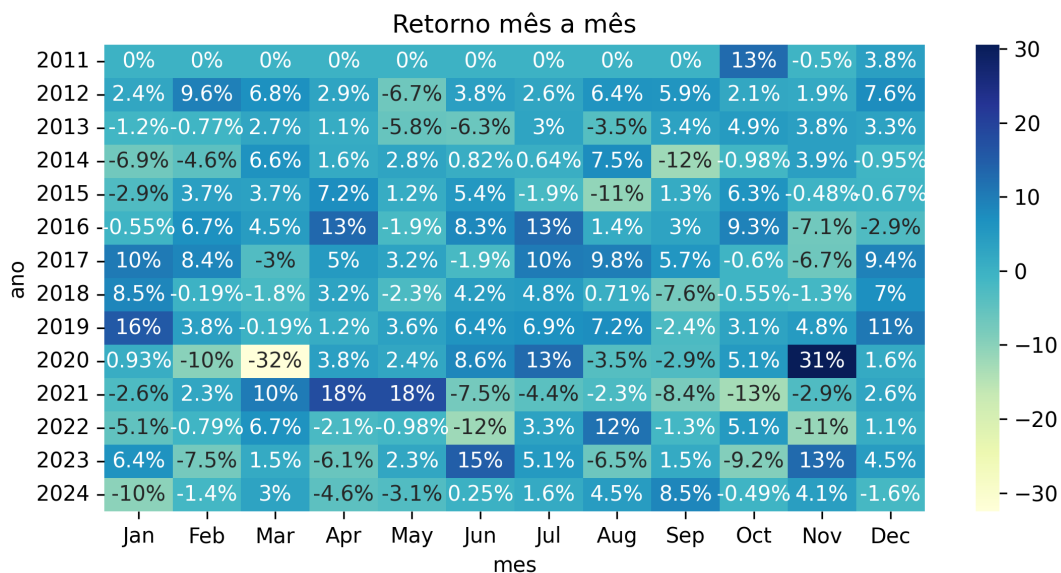
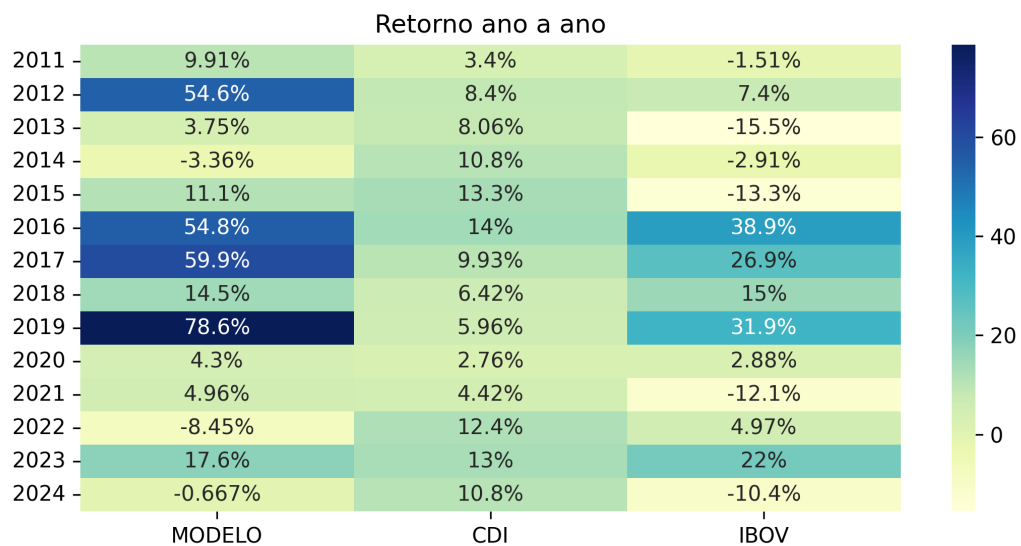
Joesley Day - 18/05/2017	-11.09%
Auge pandemia: Março - 2020	-35.5%
Boa sorte Day - 10/11/2022	-5.02%
Greve dos caminhoneiros - 2018	2.46%
Precatórios - ago/nov 2021	-22.49%
Crise de 2008	-

Períodos sem lucro

Pior período de 1 mês	-42.72%
Pior período de 3 meses	-44.3%
Pior período de 6 meses	-35.75%
Pior período de 1 ano	-41.72%
Pior período de 2 anos	-40.19%
Pior período de 3 anos	-42.9%



Relatório do Modelo



Relatório do Modelo

